

金融课后习题集：第七章外汇风险管理 PDF转换可能丢失图片或格式，建议阅读原文

https://www.100test.com/kao_ti2020/83/2021_2022__E9_87_91_E8_9E_8D_E8_AF_BE_E5_c49_83065.htm 关键词汇 Foreign

Exchange Risk Foreign Exchange Transaction Risk Foreign Exchange Translation Risk Foreign Exchange Economic Risk

Foreign Exchange Political Risk Foreign Exchange Rate Forecasting

基础因素分析预测法 市场预测法 预测误差 币值波动性 货币相关性风险识别 风险衡量 外汇风险控制 风险融资 内部风险

抑制 转移定价 问答与练习 1. 为什么需要进行汇率预测模型的

检验？常用的有哪些检验方法？ 2. 你如何看待汇率预测

出现的误差问题？如何调整预测的系统偏差？ 3. 币值变化和

货币相关关系给涉外企业会带来哪些交易风险？ 4. 对于一个

纯国内经营的企业而言，本国货币升值和贬值会带来什么样的

经济风险？ 5. 外汇风险管理应该遵循哪些原则？ 6.

叙述外汇风险管理的一般程序以及每道程序的具体内容。 7.

涉外企业在做出交易风险管理方法选择的决策时，需考虑

哪些问题？ 8. 尽管有时不进行套期保值更经济，为什么许多

企业还要运用衍生工具进行套期保值？ 9. 比较远期外汇

合同、外汇期货合同、期权合同、货币互换这四种套期保值

方法在企业交易风险管理中的利弊。 10. 在金融市场不发达

的情况下，涉外企业可以用哪些方法来降低外汇风险？这些

方法有什么局限性？ 11. 2003年12月，一家中国超市连锁公

司正在考虑一项进口计划，该公司在未来三年中将每月一次

进口50吨优等牛肉，公司目前有两个潜在的供货商，一个是

加拿大公司（以加元标价），另一个是法国（以欧元标价）

公司。按当前汇率，公司从这两个国家进口所支付的人民币（包括运费）进口价格刚好相同。假设该中国公司没有其他汇率波动风险，而且比较偏好较低的汇率风险，请通过计算交易风险，说明该公司应选择哪个供货商？

12. 假定你是一个出口商，产品出口到英国。你坚信今天英镑的远期汇率对未来的即期汇率远远低估，公司要求你对未来的英镑收入做套期保值。你认为使用远期套期保值和卖出期权哪种方式更合适？

13. 中国的一家跨国公司获得了5亿欧元的德国政府采购合同，合同将延续3年，德国政府以欧元付款。德国政府的采购约占该家公司销售量的60%，公司10%的经营费用是欧元，其他是人民币。公司的财务主管要求你提供一份报告：

（1）该公司在未来3年中会出现多大的经济风险？（2）应该采取哪些行动来降低欧元汇率波动所产生的经济风险？（3）可以获得哪些外部资源来实现外汇风险管理？

100Test 下载频道开通，各类考试题目直接下载。详细请访问 www.100test.com